



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	vi
PRAKATA	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
DAFTAR LAMBANG	xv
INTISARI	xvii
ABSTRACT	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan dan Batasan Masalah.....	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Tinjauan Pustaka.....	5
1.5 Metode Penelitian.....	10
1.6 Sistematika Penulisan.....	11
BAB II DASAR TEORI	12
2.1 Variabel Random	12
2.2 Matriks.....	27
2.3 Vektor.....	32
2.4 Analisis Multivariabel.....	34
2.5 Metode Optimisasi.....	37
2.5.1 Metode Pengali Lagrange dan Kondisi Karush-Kuhn- Trucker (KKT).....	38



2.5.2	Metode Newton Raphson.....	39
2.5.3	Pemrograman Linier.....	42
2.5.4	Pemrograman Kuadratik.....	43
2.5.5	Metode SQP (<i>Sequential Quadratically Programming</i>).....	44
2.6	Investasi dan Portofolio.....	49
2.7	Optimisasi Portofolio <i>Mean-Variance (MV)</i>	56
2.8	Optimisasi Portofolio <i>Robust Mean-Variance (MV) SOCP (Second Order Cone Programming)</i>	59
2.9	Metode Blok Bootstrap.....	64
BAB III PORTOFOLIO ROBUST MEAN-VARIANCE (MV) DAN ROBUST MEAN-VARIANCE-SKEWNESS (MVS).....		67
3.1	Optimisasi Portofolio <i>Robust Mean-Variance (MV)</i> (Modifikasi).....	67
3.2	Optimisasi Portofolio <i>Robust Mean-Variance-Skewness (MVS)</i>	76
BAB IV STUDI KASUS.....		83
4.1	Mengunduh data harga saham dan menghitung nilai <i>return (log return)</i>	83
4.2	Uji normalitas, uji signifikansi skewness serta melihat keberadaan <i>outlier</i>	85
4.3	Melakukan metode blok bootstrap untuk memperoleh nilai-nilai Parameter.....	88
4.4	Pembentukan Portofolio RMV dan RMVS dan Simulasi Portofolio Selama Lima Hari.....	89
4.4.1	Portofolio Robust Mean Variance dan Robust Mean Variance Skewness Prioritas Mean.....	90
4.4.2	Portofolio Robust Mean Variance dan Robust Mean Variance Skewness Prioritas Variansi.....	92
4.4.3	Portofolio Robust Mean Variance dan Robust Mean Variance Skewness Prioritas Skewness.....	95
4.4.4	Perbandingan Bobot Optimal dan Hasil Simulasi Portofolio RMV dan RMVS Berbagai Prioritas.....	97



BAB V PENUTUP	99
5.1 Kesimpulan.....	99
5.2 Saran.....	100
DAFTAR PUSTAKA	101
LAMPIRAN	105